

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月19日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	グローバルESGハイクオリティ成長株式ファンド（為替ヘッジな し）
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書の提出に伴い、2021年2月12日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について記載事項の一部に変更が生じることに加えて、運用再委託先の追加を行う予定があること、ファンドの運用プロセスについてより分かりやすい記載にすることのほか、関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

2 ポートフォリオの構築にあたっては、投資アイデアの分析・評価や、個別企業の競争優位性、成長力、ESG^{*2}への取り組みなどの評価に基づき選定した質の高いと考えられる企業の中から、市場価格が理論価格より割安と判断される銘柄を厳選して投資を行います。

*2 「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。

●ボトムアップ・アプローチを基本に、持続可能な競争優位性を有し、高い利益成長が期待される銘柄を選定します。

●積極的なESG課題への取り組みとその課題解決を通じて、当該企業の競争優位性が持続的に維持され、成長が期待される銘柄に注目します。

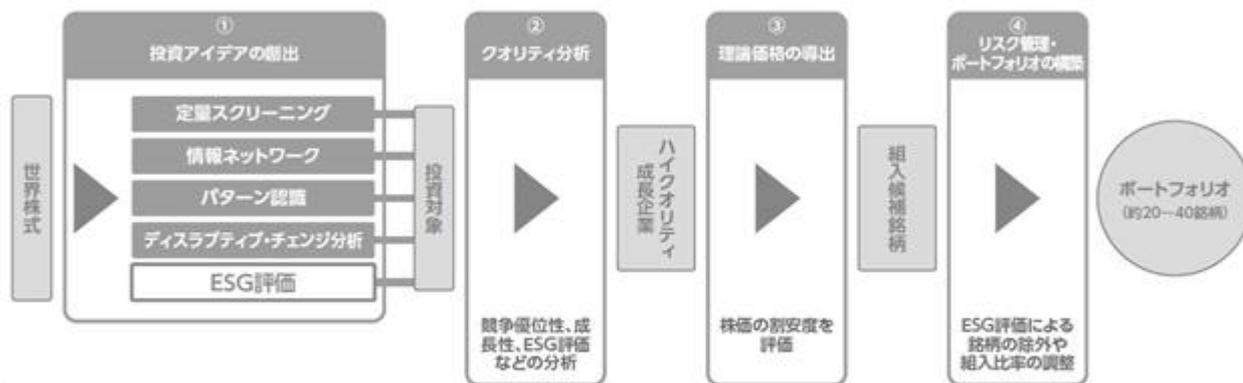
●マザーファンドの運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク^{*3}に株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託します。なお、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッド^{*4}に再委託します。

*3 モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのニューヨーク拠点です。

*4 モルガン・スタンレーの香港法人であり、証券業務、投資銀行業務、ウェルス・マネジメント業務、資産運用業務等を営んでいます。

運用プロセス

持続可能な競争優位性を有し、高い利益成長が期待される企業のうち、市場価格が理論価格より割安かつESG評価の観点から企業価値の向上が期待できる銘柄を厳選してポートフォリオを構築します。



①投資アイデアの創出

定量スクリーニング、情報ネットワーク、パターン認識、ディスラプティブ・チェンジ分析、ESG評価の5項目より投資アイデアを創出します。

定量スクリーニング

成長率や利益率など企業の財務指標に基づき銘柄を調査します。

情報ネットワーク

企業経営者、業界の専門家との面談など、運用委託先の運用チームのネットワークを活用し、銘柄を調査します。

パターン認識

成功企業のビジネスモデルを地域や国、業界等が異なる企業に当てはめ、新規の投資アイデアの発掘につなげます。

ディスラプティブ・チェンジ分析

新しい価値が既存の価値にどのようなインパクトを与え、長期的かつ巨大な変化になるのかを大局的に見極めます。

ESG評価

長期的に企業の競争優位性や企業価値を高めるような、環境および社会的課題を特定し、取り組み状況进行调查します。

②クオリティ分析

「ハイクオリティ成長企業」の発掘にあたっては、5つの観点（「競争優位性」「ディスラプティブ・チェンジ」「成長性」「財務健全性」「ESG評価」）から総合的に判断します。

③理論価格の導出

「ハイクオリティ成長企業」のうち、市場価格が理論価格より割安と判断される企業を厳選し、組入候補銘柄とします。

④リスク管理・ポートフォリオの構築

組入候補銘柄のうち、環境や社会に望ましくないと考えられる業種や企業統治面で評価の劣る銘柄を除外し、独自のESG評価に基づき組入比率を調整します。なお、各銘柄間の相関等も考慮します。

※上記はマザーファンドの運用プロセスです。

※運用プロセスは、2020年11月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

出所:モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントの情報をもとに委託会社作成

■モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのご紹介

- モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントは、モルガン・スタンレーの資産運用部門として1975年に設立されました。
- 世界23か国にある43の拠点を通じて、株式、債券等の伝統的資産運用のほか、ファンド・オブ・ファンズや非上場市場への直接投資等、さまざまな運用戦略および運用サービスを世界の投資家に提供しています（2020年9月末時点）。
- 2020年9月末時点の運用資産総額は、約7,152億米ドル（約75,7兆円*）にのぼります。

*1米ドル=105.80円（2020年9月末時点）で換算。

出所:モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのデータをもとに委託会社作成

（略）

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

2 ポートフォリオの構築にあたっては、投資アイデアの分析・評価や、個別企業の競争優位性、成長力、ESG^{*2}への取り組みなどの評価に基づき選定した質の高いと考えられる企業の中から、市場価格が理論価格より割安と判断される銘柄を厳選して投資を行います。

*2 「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。

- ボトムアップ・アプローチを基本に、持続可能な競争優位性を有し、高い利益成長が期待される銘柄を選定します。
- 積極的なESG課題への取り組みとその課題解決を通じて、当該企業の競争優位性が持続的に維持され、成長が期待される銘柄に注目します。
- マザーファンドの運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク^{*3}に株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託します。なお、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッド^{*4}に再委託します。また、2021年6月8日から、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニー^{*5}にも再委託を行う予定です。

*3 モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのニューヨーク拠点であり、資産運用業務等を営んでいます。

*4 モルガン・スタンレーの香港法人であり、証券業務、投資銀行業務、ウェルス・マネジメント業務、資産運用業務等を営んでいます。

*5 モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのシンガポール拠点であり、資産運用業務等を営んでいます。

運用プロセス

持続可能な競争優位性を有し、高い利益成長が期待される企業のうち、市場価格が理論価格より割安かつESG評価の観点から企業価値の向上が期待できる銘柄を厳選してポートフォリオを構築します。



①投資アイデアの創出

定量スクリーニング、情報ネットワーク、パターン認識、ディスラプティブ・チェンジ分析、ESG評価(アライメント)の5項目より投資アイデアを創出します。

定量スクリーニング

成長率や利益率など企業の財務指標に基づき銘柄を調査します。

情報ネットワーク

企業経営者、業界の専門家との面談など、運用委託先の運用チームのネットワークを活用し、銘柄を調査します。

パターン認識

成功企業のビジネスモデルを地域や国、業界等が異なる企業に当てはめ、新規の投資アイデアの発掘につなげます。

ディスラプティブ・チェンジ分析

新しい価値が既存の価値にどのようなインパクトを与え、長期的かつ巨大な変化になるのかを大局的に見極めます。

ESG評価(アライメント)

長期的に企業の競争優位性や企業価値を高めるような、環境および社会的課題を特定、取り組み状況を調査し、ESGアライメント(ビジネス戦略とESGの整合性)が強い企業を発掘します。

②クオリティ分析

「ハイクオリティ成長企業」の発掘にあたっては、5つの観点(競争優位性、ディスラプティブ・チェンジ、成長性、財務健全性、ESG評価(クオリティ評価)*)から総合的に判断します。

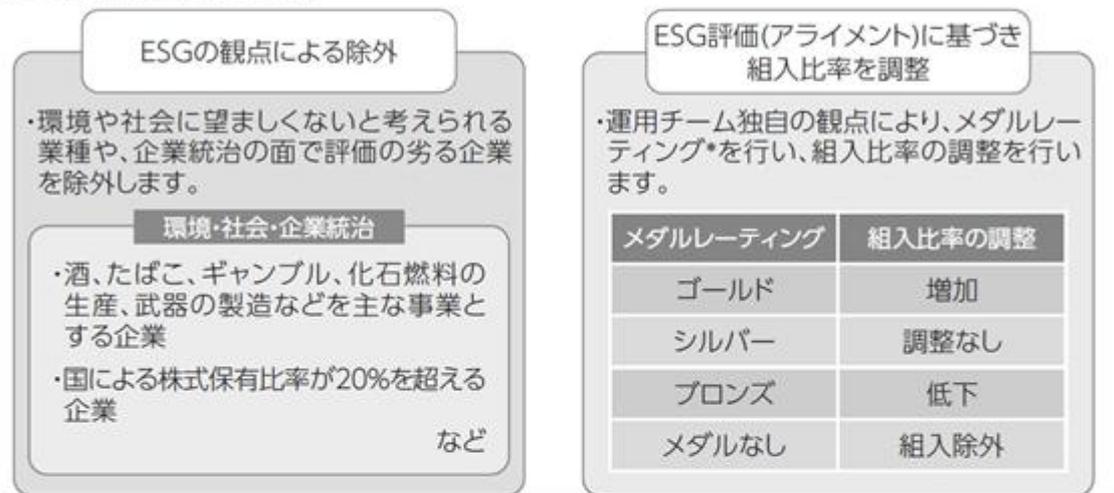
*環境や社会のネガティブな影響が限定的であることや企業統治が強固であることの評価

③理論価格の導出

「ハイクオリティ成長企業」のうち、市場価格が理論価格より割安と判断される企業を厳選し、組入候補銘柄とします。

④ポートフォリオの構築・リスク管理

各銘柄の確信度に応じて組入比率を決定します。環境や社会に望ましくないと考えられる業種や、企業統治の面で評価の劣る企業を除外します。ESG評価(アライメント)に基づき、銘柄の組入比率を調整します。なお、各銘柄間の相関等も考慮します。



*当運用プロセスにおけるメダルレーティングとは、HELP(ヘルプ=助ける)&ACT(アクト=行動を起こす)の観点により、ESGアライメント(ビジネス戦略とESGの整合性)を精査したうえで評価し、その評価に応じてゴールド、シルバー、ブロンズ、メダルなしへの分類を行うことをいいます。また、メダルレーティングに応じて銘柄の組入比率の調整を行います。

HELP&ACTの観点でESGアライメントを精査することで、ハイクオリティ成長企業の競争優位性と成長性が長期にわたって持続的に維持可能か判断することができると運用チームでは考えます。

HEALTH(健康)	: あらゆる人々の生活の質と健康の向上をめざす
ENVIRONMENT(環境)	: 気候変動およびその影響を軽減し、地球と人々を守る
LIBERTY(自由)	: 自由、平等性、プライバシー、安全性を重視する
PRODUCTIVITY(生産性)	: 持続可能な生産・消費形態の確保およびその向上をめざす
AGENCY(マネジメント責任)	: 株主との利益の方向性を一致させ、その利益の拡大をめざす経営陣たること
CULTURE(文化)	: 革新的な企業カルチャー、適応性、共通価値創造*の尊重
TRUST(信頼)	: 厳格なコーポレート・ガバナンスに基づいた適切・正確な情報開示の徹底

*共通価値創造(CSV:Creating Shared Value)は、企業の事業を通じて社会的な課題を解決することから生まれる「社会価値」と「企業価値」を高立させようとする経営フレームワークを指します。

※前述の運用プロセスは、マザーファンドのものです。

※運用プロセスは、2021年1月末時点のものです。今後予告なく変更される場合があります。

出所:モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントの情報をもとに委託会社作成

■モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのご紹介

- モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントは、モルガン・スタンレーの資産運用部門として1975年に設立されました。
- 世界23カ国にある43の拠点を通じて、株式、債券等の伝統的資産運用のほか、ファンド・オブ・ファンズや非上場市場への直接投資等、さまざまな運用戦略および運用サービスを世界の投資家に提供しています(2020年12月末時点)。
- 2020年12月末時点の運用資産総額は、約7,813億米ドル(約80.9兆円*)にのぼります。

*1米ドル=103.50円(2020年12月末時点)で換算。

出所:モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントのデータをもとに委託会社作成

(略)

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

* モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。

(略)

・「投資一任契約」の概要

委託会社と投資顧問会社(モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク)との間においては、グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託する契約を締結しております。^{*}

当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものです。

* モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(2020年11月30日現在)

(略)

大株主の状況

(2020年11月30日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1: A種種類株式(15,510株)を含みます。

2: 普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

<訂正後>

(略)

* モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。—

2021年6月8日から、再委託先にモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーを追加する予定です。

(略)

・「投資一任契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク）との間においては、グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託する契約を締結しております。^{*}

当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものです。

*モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部（株式等の投資判断の一部）を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。－

2021年6月8日から、再委託先にモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーを追加する予定です。

（略）

委託会社の概況

（略）

資本金の額

20億円（2021年1月29日現在）

（略）

大株主の状況

（2021年1月29日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>主としてわが国および新興国を含む世界の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）^(*)に投資を行い、信託財産の成長をめざして積極的な運用を行います。</p> <p>^(*)DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p> <p>ボトムアップ・アプローチを基本に、持続可能な競争優位性を有し、高い利益成長が期待される銘柄を選定します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、投資アイデアの分析・評価や、個別企業の競争優位性、成長力、ESG^(*)への取り組みなどの評価に基づき選定した質の高いと考えられる企業の中から、市場価格が理論価格より割安と判断される銘柄を厳選して投資を行います。</p> <p>^(*)「ESG」とは、環境（Environment）、社会（Social）、企業統治（Governance）の略称です。</p> <p>株式等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用の指図に関する権限の一部を委託します。なお、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部（株式等の投資判断の一部）を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
(略)	

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

<訂正後>

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド
(略)	

投資態度	<p>主としてわが国および新興国を含む世界の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)^(*)に投資を行い、信託財産の成長をめざして積極的な運用を行います。</p> <p>(*) DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p> <p>ボトムアップ・アプローチを基本に、持続可能な競争優位性を有し、高い利益成長が期待される銘柄を選定します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、投資アイデアの分析・評価や、個別企業の競争優位性、成長力、ESG^(*)への取り組みなどの評価に基づき選定した質の高いと考えられる企業の中から、市場価格が理論価格より割安と判断される銘柄を厳選して投資を行います。</p> <p>(*) 「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。</p> <p>株式等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用の指図に関する権限の一部を委託します。なお、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。—</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>2021年6月8日から、再委託先にモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーを追加する予定です。</p> </div> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
(略)	

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

<訂正前>

a. ファンドの運用体制

(略)

運用の指図に関する権限の委託

当ファンドが投資対象とするグローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドは、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクにグローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託します。^{*}

モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは投資一任契約に基づいてグローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの運用計画を策定・報告し、運用指図および売買執行・管理を行います。

^{*}モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。

(略)

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの運用指図権限の委託先の運用体制は以下の通りです。

当マザーファンドは、信託財産の運用指図に関する権限の一部をモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに委託します。^{*}

*モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部（株式等の投資判断の一部）を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。

（略）

上記体制は2020年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

a. ファンドの運用体制

（略）

運用の指図に関する権限の委託

当ファンドが投資対象とするグローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドは、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクにグローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託します。^{*}

モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは投資一任契約に基づいてグローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの運用計画を策定・報告し、運用指図および売買執行・管理を行います。

*モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部（株式等の投資判断の一部）を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。－

2021年6月8日から、再委託先にモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーを追加する予定です。

（略）

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの運用指図権限の委託先の運用体制は以下の通りです。

当マザーファンドは、信託財産の運用指図に関する権限の一部をモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに委託します。^{*}

*モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、その委託を受けた運用の指図に関する権限の一部（株式等の投資判断の一部）を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。－

2021年6月8日から、再委託先にモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーを追加する予定です。

（略）

上記体制は2021年1月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスク管理体制>

(略)

リスク管理体制は2020年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

<リスク管理体制>

(略)

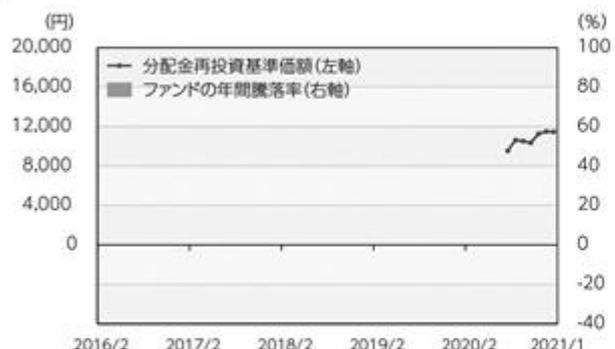
リスク管理体制は2021年1月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

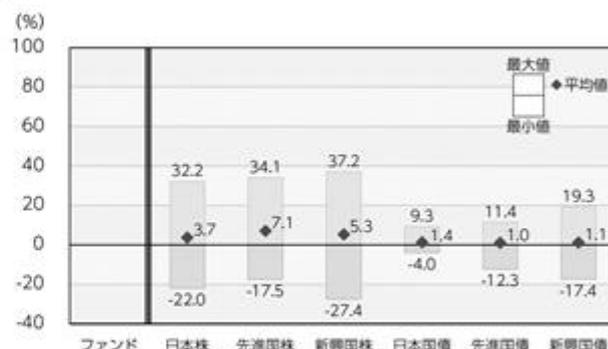
<更新・訂正後>

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2021年1月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2016年2月～2021年1月

*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*ファンドは2021年1月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIコクサイ・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIエマージング・マーケット・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	[NOMURA-BPI国債]は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	[FTSE世界国債インデックス(除く日本)]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)

委託会社の信託報酬には、グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の委託を受けた投資顧問会社（モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク）に対する報酬（当ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの純資産総額に対して年率0.65%）が含まれます。

なお、当該投資顧問会社に対する報酬には、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに対する報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

<訂正後>

(略)

委託会社の信託報酬には、グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の委託を受けた投資顧問会社（モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク）に対する報酬（当ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの純資産総額に対して年率0.65%）が含まれます。

なお、当該投資顧問会社に対する報酬には、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに対する報酬が含まれます。^{*}

<p>*2021年6月8日から、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーに対する報酬も含まれる予定です。</p>

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2020年11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(略)

<訂正後>

(略)

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2021年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(略)

5【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

2021年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	919,115,654,077	99.34
内 日本	919,115,654,077	99.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,099,140,129	0.66
純資産総額	925,214,794,206	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

2021年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	894,862,589,322	97.36
内 アメリカ	611,657,286,477	66.55
内 ケイマン諸島	61,639,262,265	6.71
内 インド	54,186,398,876	5.90
内 ルクセンブルグ	34,550,014,971	3.76
内 イタリア	32,117,140,871	3.49
内 デンマーク	30,561,132,977	3.33
内 日本	26,823,692,000	2.92
内 カナダ	25,515,560,701	2.78
内 フランス	17,812,100,184	1.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	24,262,173,538	2.64
純資産総額	919,124,762,860	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2021年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	792,956,305,821	1.0378 823,000,000,000	1.1591 919,115,654,077	- -	99.34

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年1月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.34

合計	99.34
----	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

2021年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	205,621	328,006.06 67,444,934,909	338,266.53 69,554,703,727	- -	7.57
2	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	1,883,248	33,796.48 63,647,164,785	33,880.77 63,805,900,627	- -	6.94
3	TAL EDUCATION GROUP-ADR ケイマン諸島	株式 各種消費 者サービ ス	7,851,508	7,903.06 62,050,985,987	7,850.62 61,639,262,265	- -	6.71
4	UBER TECHNOLOGIES INC アメリカ	株式 陸運・鉄 道	11,388,591	4,046.49 46,083,820,843	5,389.07 61,374,009,764	- -	6.68
5	SERVICENOW INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,015,095	49,113.24 49,854,606,892	57,906.99 58,781,101,292	- -	6.40
6	HDFC BANK LTD ADR インド	株式 銀行	7,203,186	5,662.68 40,789,358,450	7,522.55 54,186,398,876	- -	5.90
7	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	2,656,299	14,542.79 38,630,009,696	17,958.02 47,701,876,943	- -	5.19
8	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	911,751	48,462.76 44,185,974,734	48,653.20 44,359,605,212	- -	4.83
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	2,036,860	21,170.88 43,122,121,646	20,710.02 42,183,422,743	- -	4.59
10	SQUARE INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	1,626,628	15,891.78 25,850,020,216	22,976.19 37,373,725,048	- -	4.07
11	SPOTIFY TECHNOLOGY SA ルクセンブルグ	株式 娯楽	1,016,118	29,328.21 29,800,929,083	34,001.97 34,550,014,971	- -	3.76
12	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	837,435	33,950.61 28,431,431,216	39,555.08 33,124,811,099	- -	3.60

13	MONCLER SPA イタリア	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	5,280,320	4,577.03 24,168,228,109	6,082.42 32,117,140,871	- -	3.49
14	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,270,738	22,416.78 28,485,863,988	23,664.71 30,071,658,963	- -	3.27
15	キーエンス 日本	株式 電気機器	477,800	47,411.43 22,653,182,803	56,140.00 26,823,692,000	- -	2.92
16	SHOPIFY INC カナダ	株式 情報技術 サービス	217,938	105,085.36 22,902,094,955	117,077.15 25,515,560,701	- -	2.78
17	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	127,901	165,915.13 21,220,711,224	194,657.73 24,896,918,682	- -	2.71
18	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	778,793	26,790.25 20,864,065,765	27,687.19 21,562,597,549	- -	2.35
19	BALL CORP アメリカ	株式 容器・包 装	2,229,075	8,296.75 18,494,098,560	9,221.40 20,555,202,904	- -	2.24
20	ILLUMINA INC アメリカ	株式 ライフサ イエ ス・ツ ール/サー ビス	415,672	38,461.19 15,987,240,814	45,785.22 19,031,636,295	- -	2.07
21	ECOLAB INC アメリカ	株式 化学	850,059	21,569.21 18,335,106,287	22,055.72 18,748,670,087	- -	2.04
22	INTUITIVE SURGICAL INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ 用品	231,745	72,361.89 16,769,506,990	79,964.81 18,531,445,542	- -	2.02
23	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	2,427,064	7,424.47 18,019,668,451	7,425.71 18,022,686,764	- -	1.96
24	HERMES INTL フランス	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	163,451	96,997.43 15,854,328,122	108,975.16 17,812,100,184	- -	1.94
25	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S デンマーク	株式 化学	1,324,806	11,807.72 15,642,944,249	9,464.36 12,538,446,213	- -	1.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年1月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.36
合計	97.36

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年1月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	2.92
情報技術サービス	外国	18.37
ソフトウェア		18.10
娯楽		8.95
インターネット販売・通信販売		7.57
各種消費者サービス		6.71
陸運・鉄道		6.68
銀行		5.90
繊維・アパレル・贅沢品		5.43
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.05
化学		3.40
容器・包装		2.24
ライフサイエンス・ツール / サービス		2.07
ヘルスケア機器・用品		2.02
医薬品		1.96
合計		97.36

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2021年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
2020年7月末日	392,631	-	0.9571	-
8月末日	523,927	-	1.0615	-

9月末日	602,907	-	1.0523	-
10月末日	658,361	-	1.0347	-
11月末日	779,687	-	1.1258	-
12月末日	882,510	-	1.1495	-
2021年1月末日	925,214	-	1.1462	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
2020年7月20日～2021年1月19日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2020年7月20日～2021年1月19日	12.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
2020年7月20日～ 2021年1月19日	801,885,665,972	15,869,164,926

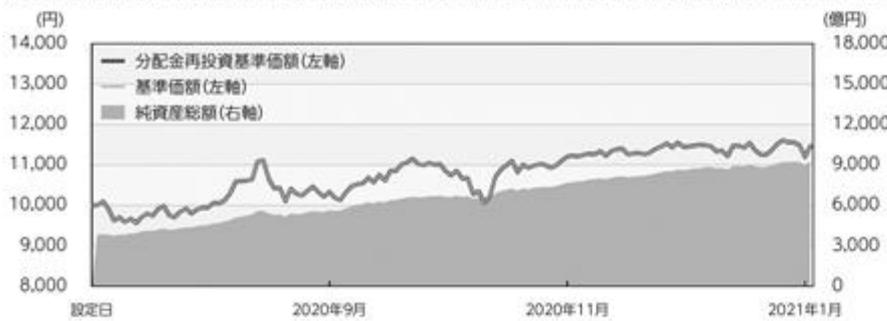
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 設定口数には、当初設定口数を含みます。

《参考情報》

データの基準日:2021年1月29日

基準価額・純資産の推移 (2020年7月20日～2021年1月29日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2020年7月20日)

分配の推移(税引前)

基準日現在、分配実績
はありません。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド	99.34

■グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

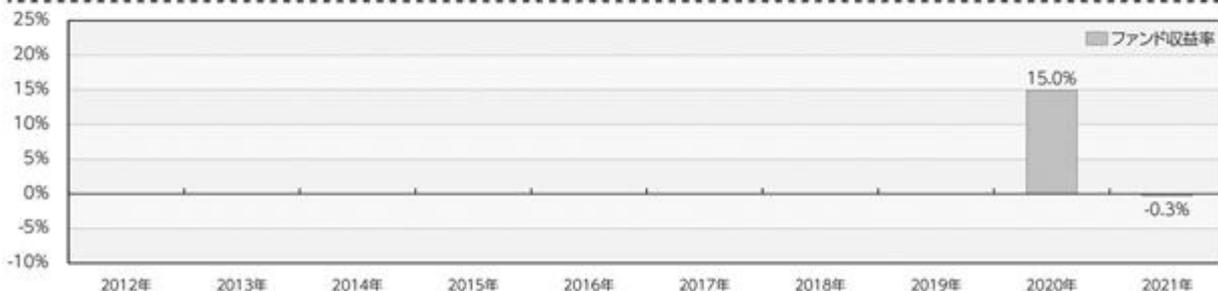
組入上位10銘柄

資産の種類	比率(%)	順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
株式	97.36	1	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	7.57
内 アメリカ	66.55	2	MASTERCARD INC	株式	アメリカ	情報技術サービス	6.94
内 ケイマン諸島	6.71	3	TAL EDUCATION GROUP-ADR	株式	ケイマン諸島	各種消費者サービス	6.71
内 インド	5.90	4	UBER TECHNOLOGIES INC	株式	アメリカ	陸運・鉄道	6.68
内 ルクセンブルグ	3.76	5	SERVICENOW INC	株式	アメリカ	ソフトウェア	6.40
内 イタリア	3.49	6	HDFC BANK LTD ADR	株式	インド	銀行	5.90
内 その他	10.95	7	THE WALT DISNEY CO	株式	アメリカ	娯楽	5.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.64	8	ADOBE INC	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.83
合計(純資産総額)	100.00	9	VISA INC	株式	アメリカ	情報技術サービス	4.59
		10	SQUARE INC	株式	アメリカ	情報技術サービス	4.07

株式組入上位5業種

国内/外国	順位	業種	比率(%)
外国	1	情報技術サービス	18.37
	2	ソフトウェア	18.10
	3	娯楽	8.95
	4	インターネット販売・通信販売	7.57
	5	各種消費者サービス	6.71
国内	1	電気機器	2.92

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2020年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間（2020年7月20日から2021年1月19日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバルESGハイクオリティ成長株式ファンド(為替ヘッジなし)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第1期中間計算期間末 2021年1月19日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,082,622,052
親投資信託受益証券	879,134,381,436
流動資産合計	892,217,003,488
資産合計	892,217,003,488
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,269,769,075
未払受託者報酬	107,319,032
未払委託者報酬	5,902,549,315
その他未払費用	1,955,160
流動負債合計	7,281,592,582
負債合計	7,281,592,582
純資産の部	
元本等	
元本	786,016,501,046
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	98,918,909,860
(分配準備積立金)	-
元本等合計	884,935,410,906
純資産合計	884,935,410,906
負債純資産合計	892,217,003,488

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2020年7月20日 至 2021年1月19日
営業収益	
受取利息	5,494
有価証券売買等損益	79,634,381,436
営業収益合計	79,634,386,930
営業費用	
支払利息	902,089
受託者報酬	107,319,032
委託者報酬	5,902,549,315
その他費用	1,955,160
営業費用合計	6,012,725,596
営業利益又は営業損失()	73,621,661,334
経常利益又は経常損失()	73,621,661,334
中間純利益又は中間純損失()	73,621,661,334
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,321,222,533
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,879,797,740
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,879,797,740
剰余金減少額又は欠損金増加額	261,326,681
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	261,326,681
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	98,918,909,860

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期中間計算期間
	自 2020年7月20日 至 2021年1月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間末 2021年1月19日現在
1. 期首元本額	383,033,244,716円
期中追加設定元本額	418,852,421,256円
期中一部解約元本額	15,869,164,926円
2. 受益権の総数	786,016,501,046口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期中間計算期間
	自 2020年7月20日 至 2021年1月19日
1. 委託費用	信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 (注)当該金額は、親投資信託の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額のうち、信託財産に属する額になっております。 2,121,890,703円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間末 2021年1月19日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期中間計算期間末 2021年1月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1258円 (11,258円)

（参考）

当ファンドは、「グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年1月19日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,420,027,773
コール・ローン	7,487,463,026
株式	858,129,644,997
派生商品評価勘定	347,985
未収配当金	74,724,850
流動資産合計	879,112,208,631
資産合計	879,112,208,631
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	772,729,525,742
剰余金	
剰余金又は欠損金()	106,382,682,889
元本等合計	879,112,208,631
純資産合計	879,112,208,631
負債純資産合計	879,112,208,631

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年7月20日 至 2021年1月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年1月19日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	- 円
同期中追加設定元本額	772,729,525,742円
同期中一部解約元本額	- 円
元本の内訳	
ファンド名	
グローバルESGハイクオリティ成長株式ファンド（為替ヘッジなし）	772,729,525,742円
計	772,729,525,742円
2. 受益権の総数	772,729,525,742口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年1月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年1月19日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	2,955,957,015	-		2,956,305,000	347,985
	2,955,957,015	-		2,956,305,000	347,985
合計	2,955,957,015	-		2,956,305,000	347,985

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年1月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1377円 (11,377円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年1月29日現在

資産総額	926,033,924,469円
負債総額	819,130,263円
純資産総額(-)	925,214,794,206円
発行済数量	807,182,754,436口
1口当たり純資産額(/)	1.1462円

(参考)

グローバルESGハイクオリティ成長株式マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	925,537,971,191円
負債総額	6,413,208,331円
純資産総額(-)	919,124,762,860円
発行済数量	792,956,305,821口
1口当たり純資産額(/)	1.1591円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金の額（2020年11月30日現在）

（略）

(2) 会社の機構（2020年11月30日現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2021年1月29日現在）

（略）

(2) 会社の機構（2021年1月29日現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

（略）

2020年11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,424,219,612,532
追加型株式投資信託	853	14,458,430,616,466
単位型公社債投資信託	34	77,591,955,040
単位型株式投資信託	196	1,282,801,429,704
合計	1,109	17,243,043,613,742

<訂正後>

（略）

2021年1月29日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,484,671,512,599
追加型株式投資信託	853	15,042,734,133,633
単位型公社債投資信託	32	74,310,285,576
単位型株式投資信託	203	1,289,577,521,784
合計	1,114	17,891,293,453,592

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(略)

(3)投資顧問会社

名称	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・ インク [*]
資本金の額	約475,872千米ドル(2019年12月末日現在)
事業の内容	米国において投資助言及び投資運用業務を営んでいます。

^{*} 委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。

<訂正後>

(略)

(3)投資顧問会社

名称	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・ インク [*]
資本金の額	約475,872千米ドル(2019年12月末日現在)
事業の内容	米国において投資助言及び投資運用業務を営んでいます。

^{*} 委託を受けた運用の指図に関する権限の一部(株式等の投資判断の一部)を、モルガン・スタンレー・アジア・リミテッドに再委託します。^{*}

[*] 2021年6月8日から、再委託先にモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・カンパニーを追加する予定です。

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月5日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルESGハイクオリティ成長株式ファンド（為替ヘッジなし）の2020年7月20日から2021年1月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバルESGハイクオリティ成長株式ファンド（為替ヘッジなし）の2021年1月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月20日から2021年1月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。